

На правах рукописи



БЕЛЯЕВА АННА ДМИТРИЕВНА

**ИСТОРИЯ ВОЗНИКНОВЕНИЯ И ЭВОЛЮЦИЯ
ЭКСПЕРИМЕНТАЛЬНОЙ ЭКОНОМИКИ ВО ВТОРОЙ ПОЛОВИНЕ
XX – НАЧАЛЕ XXI ВЕКА**

Специальность 08.00.01 – Экономическая теория

АВТОРЕФЕРАТ
диссертации на соискание ученой степени кандидата
экономических наук



Санкт-Петербург – 2013

Работа выполнена в Федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего профессионального образования «Санкт-Петербургский государственный экономический университет».

Научный руководитель- доктор экономических наук, профессор
Лабудин Александр Васильевич

Официальные оппоненты: **Широкоград Леонид Дмитриевич**,
заслуженный деятель науки РФ,
доктор экономических наук, профессор,
ФГБОУ ВПО «Санкт-Петербургский государствен-
ственный университет», профессор
кафедры экономической теории
Медников Валерий Васильевич,
кандидат экономических наук, профессор,
Санкт-Петербургский филиал НОАНО ВПО
«Институт бизнеса и политики», профессор
кафедры экономики и финансов

Ведущая организация - Санкт-Петербургский филиал Федераль-
ного государственного автономного образо-
вательного учреждения высшего профес-
сионального образования «Национальный
исследовательский университет "Высшая
школа экономики"»

Защита диссертации состоится “2” июля 2013 года в 10
часов на заседании диссертационного совета Д 212.237.01 при
Федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении
высшего профессионального образования «Санкт-Петербургский
государственный экономический университет» по адресу: 191023, Санкт-
Петербург, ул. Садовая, д.21, ауд. 3040

С диссертацией можно ознакомиться в библиотеке Федерального
государственного бюджетного образовательного учреждения высшего
профессионального образования «Санкт-Петербургский государственный
экономический университет».

Автореферат разослан “30” мая 2013 г.

Ученый секретарь
диссертационного совета



Л. А. Миэринь

I. ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА РАБОТЫ

Актуальность темы диссертационного исследования. Экспериментальная экономика является новым направлением экономической науки, посвященным использованию метода контролируемого эксперимента с целью тестирования предсказаний экономической теории и изучения поведения экономических агентов. Это направление, по сути, ввело в экономическую науку новый метод исследования – контролируемый лабораторный эксперимент.

До появления экспериментальной экономики экономическая теория считалась наукой неэкспериментальной, и признавалась методологическая и практическая невозможность проведения экспериментов. История экспериментальной экономики началась с проведения первых экономических экспериментов в 40-50-х годах XX века. Долгое время исследования в данной области считались псевдонаучными и не воспринимались всерьез не только научным сообществом, но подчас и самими авторами исследований.

Всеобщее признание экспериментальной экономики как нового направления экономической мысли стало очевидным только в 2002 году с присуждением Нобелевской премии по экономике Вернону Смиту и Даниэлю Канеману. Первого можно по праву назвать отцом экспериментальной экономики, а второй является наиболее ярким представителем поведенческой экономики.

Экспериментальная экономика ставит своей главной целью улучшение предсказательной силы экономических теорий и их большее соответствие реальности. Для этого проводится проверка существующих теорий, их модифицирование в случае необходимости и разработка на основе экспериментальных данных новых теорий, более точно описывающих реальное поведение людей.

Актуальность экспериментальной экономики заключается в необходимости изучения индивидуального, но в еще большей степени группового поведения людей, подчас необъяснимого с помощью традиционной теории. Ярким тому примером являются такие события в мировой экономике как кризисы, бумы, связанные с ними панические настроения и необъяснимое поведение масс людей, которое нуждается, но не находит должного объяснения в стандартной экономической теории. Особенно это актуально в свете кризисного состояния мировой экономики, когда в экономически нестабильной ситуации нередко наблюдаются отклонения от рационального поведения в массовом порядке, что особенно свойственно субъектам финансовых рынков.

Экспериментальная экономика, являясь новым направлением экономической науки, характеризуется новизной своей исследовательской программы, активным развитием и перспективностью. Актуальность данной темы исследования обусловлена необходимостью систематизации и анализа истории становления экспериментальной экономики для ее дальнейшего развития, в особенности в России, где исследования по данной тематике не получили такого широкого распространения, как в западных странах. Существует ограниченное количество российских экспериментальных исследований и на сегодняшний день еще рано говорить о наличии сформировавшегося научного сообщества эксперименталистов. Кроме того, в российской науке практически не существует исследований по методологии и истории экспериментальной экономики и это направление мало известно в научных кругах. Интерес изучения истории экспериментальной экономики обусловлен существующей необходимостью интеграции в историю экономической мысли ее новейших этапов, напрямую связанных с экспериментальной и поведенческой экономикой.

Степень разработанности научной проблемы. В связи с новизной данного направления полноценная история экспериментальной экономики еще не написана. Это отмечают многие ведущие специалисты в области экспериментальной экономики: Э. Рот, Ф. Гуала и другие. Краткие исторические описания можно найти в работах В. Смита, Д. Дэвиса, Ч. Хольта, Э. Рота, Ш. Харгривз Хипа, Я. Варуфакиса и П. Мировски. Из профессиональных историков только Р. Леонард исследовал экспериментальную экономику, но сосредоточился на экспериментах в области торгов. Определенным этапам истории экспериментальной экономики посвящены три диссертационные работы: К. С. Ли, Э. М. Ник-Каха и, Ф. Хейкеломе.

Основная сложность изучения истории данного направления заключается в его ярко выраженном междисциплинарном характере и в том, что ранняя история экспериментальной экономики не представляет собой единого целого, ее становление происходило в контексте разрозненных индивидуальных исследований специалистов из разных областей науки.

В изучение рассматриваемой автором проблематики внесли значительный вклад, в первую очередь, иностранные ученые, работавшие над историей и методологией экспериментальной экономики. Основным специалистом в данной области является итальянский философ и историк науки Франческо Гуала. Описания некоторых преимущественно ранних этапов развития экспериментальной экономики можно найти во введениях к сборникам, посвященным экспериментальной экономике, таких как

«Handbook of experimental economics» под редакцией Джона Кагеля и Элвина Рота и «Micro-économie expérimentale» Аурэлио Маттеи.

Зарубежные исследования американских, немецких и французских ученых в области экспериментальной экономики или смежных направлений представлены в работах В. Смита, Э. Рота, Д. Канемана, Ч. Плотта, А. Тверски, Г. Лёвенштайн, Х. Сауерманна, К. Камерера, Дж. Кагеля, Р. Талера, Дж. Кнетча, Э. Хоффман, К. МакГейба, Г. Лумза, П. Словик и других.

Существует ряд работ ученых, не занимавшихся напрямую исследованиями в экспериментальной экономике, но внесших свой вклад в ее развитие: Л. Терстона, М. Алле, Г. Саймона, Д. Эллсберга, Дж. Нэша, Э. Чемберлина, Р. Фуракера, С. Зигеля, М. Фридмана, М. Флуда, М. Дрешера, Д. Бернулли, С. Руссеса, А. Харта, Дж. Фон Неймана, О. Моргенштерна и других.

В трудах российских ученых содержится оценка роли экспериментальной экономики в современной экономической теории. Среди них следует, в первую очередь, отметить работы А. В. Белянина, В. Л. Макарова, а также Ю. П. Воронова, И. А. Павлова, Д. В. Давыдова, А. А. Тарасова и Г. Ю. Трофимова.

В русскоязычной научной литературе до сих пор недостаточно представлены публикации не только по истории данного направления, но и по самой экспериментальной экономике, что и явилось стимулом для проведения диссертационного исследования. Данная диссертационная работа призвана в известной степени восполнить этот пробел. Изучение истории экспериментальной экономики позволяет увидеть долгосрочные тенденции ее развития, увязать различные исторические процессы воедино.

Целью диссертационного исследования является комплексный анализ процесса формирования нового направления в исследовании экономических явлений, получившего название «экспериментальная экономика»; изучение ее методологических основ; определение вклада в экономическую науку и обоснование признания экспериментальной экономики как нового направления экономической теории.

В соответствии с указанной целью были поставлены следующие задачи:

- сформулировать определение экспериментальной экономики; выявить предпосылки ее возникновения;
- исследовать методологию и технику проведения лабораторных экономических экспериментов; осуществить критический анализ экспериментальной экономики;

– разделить историю возникновения и развития экспериментальной экономики на этапы и дать им характеристику и оценку, проследив преемственность взглядов; выявить и описать основные эксперименты, явившиеся вехами в истории экспериментальной экономики и определившие направление ее дальнейшего развития, а также вклад отдельных ученых в формирование данного направления, и в особенности Вернона Смита;

– описать российский опыт применения экспериментальных методов в экономике и выделить основные направления данных исследований;

– осуществить сравнительный анализ экспериментальной экономики и смежного с ней направления – поведенческой экономики;

– систематизировать и оценить значимость основных результатов исследований в рамках экспериментальной экономики; рассмотреть дуалистический характер рациональности в рамках экспериментальной экономики;

– проанализировать современное состояние экспериментальной экономики и выделить основные ее черты, области применения и перспективы развития экспериментальной экономики.

Объектом исследования настоящей диссертационной работы является экспериментальная экономика как новое направление в экономической науке.

Предметом исследования выступает эволюция экспериментальной экономики во второй половине XX - начале XXI века и ее современное состояние.

Теоретическую и методологическую основу исследования составляют оригинальные фундаментальные труды, монографии, научные статьи зарубежных и отечественных ученых, посвященные описанию экономических экспериментов и методологии экспериментальной экономики, а также истории ее развития. Для написания диссертации были использованы преимущественно редкие для России непереведенные на русский язык книги и научные статьи на английском и французском языках.

Методология исследования предполагает использование историко-аналитического метода с выходом на синтез. Применялись общенаучный системный метод исследования, метод абстрагирования и исторический метод, а также междисциплинарный подход для изучения проблемы преемственности и диверсификации экономической мысли.

Информационной базой исследования послужили материалы периодической экономической печати, официальные материалы

Нобелевского комитета, данные сайтов сети Интернет лабораторий и исследователей по экспериментальной экономике.

Соответствие диссертации Паспорту научной специальности. Область исследования соответствует следующим пунктам Паспорта научной специальности ВАК 08.00.01 – Экономическая теория: п. 3. История экономической мысли: 3.8. Возникновение новых школ и направлений экономической мысли в условиях трансформации капитализма, краха государственной общественной системы и глобализации экономических процессов; 3.9. Направления взаимовлияния и интеграции различных направлений и школ экономической мысли.

Научная новизна результатов исследования заключается в том, что автором впервые проведен комплексный анализ истории возникновения и развития экспериментальной экономики с разделением ее на этапы и их характеристикой, изучена методология и результаты исследований в рамках экспериментальной экономики, что позволило обосновать ее признание в качестве нового перспективного направления экономической науки и дать ее развернутую характеристику. В научный оборот впервые вводятся не переведенные на русский язык источники.

Наиболее существенные результаты исследования, обладающие научной новизной и полученные лично соискателем:

- дано авторское определение экспериментальной экономики, уточнено понятие «экономический эксперимент»; на основе исследования исторического контекста появления экспериментальной экономики выявлены предпосылки ее зарождения, а также междисциплинарный характер исследований в данной области;

- на основе обобщения и сравнительного анализа научных воззрений зарубежных и отечественных ученых по проблеме применения экспериментальных методов в экономике осуществлена систематизация и классификация сложившихся в научной литературе этапов, техник, принципов, видов процедур и субъектов экономических экспериментов; выявлены границы применения методов экспериментальной экономики;

- впервые определена хронология исследований и осуществлен первый в отечественной науке комплексный историко-экономический анализ возникновения и развития экспериментальной экономики от первых разрозненных экспериментов до ее признания как научного направления в настоящее время, что позволило сформировать авторскую концепцию периодизации истории возникновения экспериментальной экономики, основными элементами которой являются:

- описание основных экспериментов, явившихся вехами в истории экспериментальной экономики и определивших направление ее дальнейшего развития;

- характеристика и оценка каждого этапа истории эволюции экспериментальной экономики;
- раскрытие определенных черт генезиса экспериментальной экономики;
- оценка вклада ученых в развитие данного направления, в особенности Вернона Смита;
 - на основе анализа работ российских ученых осуществлена систематизация российского опыта применения экспериментальной экономики и выявлены перспективы развития экспериментальных исследований в России;
 - показаны различия в методах и выводах экспериментальной и поведенческой экономик;
 - проведен анализ и оценка результатов исследований в рамках экспериментальной экономики с целью выявления ее вклада в экономическую науку и обоснования ее роли в развитии современной экономической теории; выявлен и охарактеризован дуалистический характер рациональности в рамках экспериментальной экономики, заключающийся в параллельном существовании двух видов рациональности: конструктивистской и экологической;
 - проведен анализ и характеристика основных черт экспериментальной экономики на современном этапе ее развития; проведена систематизация областей применения экспериментальной экономики; выделены преимущества экспериментальных методов и обосновано ее признание в качестве нового перспективного направления экономической теории; выявлены возможности научного и практического использования разработанного в ее рамках исследовательского аппарата и выявлены перспективы ее развития.

Теоретическая значимость исследования определяется научно-практической актуальностью поставленных задач и заключается в проведенном впервые комплексном анализе истории возникновения нового направления в экономической науке, в определении его границ и выявлении перспектив развития экспериментальной экономики в контексте развития экономической науки в целом.

Данное исследование позволяет углубить теоретические представления отечественных исследователей об этом новом направлении и инициировать развитие экспериментальных экономических исследований в России.

Практическая значимость исследования. Материалы диссертационного исследования могут быть использованы в учебном процессе при чтении лекций и проведении семинарских занятий по дисциплинам

«История экономической мысли», «Экономическая теория» и «Экспериментальная и поведенческая экономика». Результаты исследования могут послужить базой для последующих научных работ по истории экономической мысли, в частности, в плане освещения новейших этапов и тенденций развития экономической теории. Кроме того, изложенные в работе методологические аспекты проведения экономических экспериментов и теоретические аспекты экспериментальной экономики могут быть использованы специалистами, непосредственно работающими в данной области.

Апробация результатов исследования. Основные положения и результаты диссертационного исследования докладывались и обсуждались на научных сессиях профессорско-преподавательского состава, научных сотрудников и аспирантов СПбГЭУ за 2010 и 2012 годы.

Публикации результатов исследования. По теме диссертационного исследования опубликовано 4 научных работы общим объемом 2,1 п.л., в том числе три в научных экономических изданиях, входящих в список ВАК РФ.

Структура диссертации. Диссертация состоит из введения, трех глав, заключения, библиографического списка использованной литературы, насчитывающего 184 источника, и приложений.

Во **введении** обосновывается актуальность темы, определяются объект и предмет, методологическая и информационная база исследования, ставятся цели и задачи, раскрываются научные результаты исследования, их теоретическая и практическая значимость.

В **первой главе** «Методологические основы экспериментальной экономики» дано определение экспериментальной экономики, описаны предпосылки ее возникновения и методология исследований в рамках данного направления. Особое внимание уделяется проблемам применения экспериментальных методов в экономике.

Во **второй главе** «История возникновения и развития экспериментальной экономики» посвящена анализу истории экспериментальной экономики. Предложена ее периодизация и осуществлен анализ опыта применения экспериментальных исследований в российской экономической науке.

В **третьей главе** «Вклад экспериментальной экономики в экономическую науку и перспективы ее развития» выявлены различия между экспериментальной и поведенческой экономикой, представлена систематизация основных результатов исследований в рамках экспериментальной экономики, а также определен ее вклад в экономическую науку, представлены результаты анализа основных характерных черт экспериментальной экономики на современном этапе ее развития,

обосновано признание экспериментальной экономики в качестве научного направления и выявлены перспективы дальнейших исследований.

В заключении подводятся итоги, излагаются основные выводы и наиболее важные результаты проведенного исследования.

В приложении представлен список исследовательских центров, занимающихся экспериментальной экономикой, их количество по странам, а также приведена синтетическая таблица этапов истории развития экспериментальной экономики.

II. ОСНОВНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ ДИССЕРТАЦИОННОГО ИССЛЕДОВАНИЯ, ВЫНОСИМЫЕ НА ЗАЩИТУ

Экспериментальная экономика как новое направление экономической науки и предпосылки ее возникновения во второй половине XX века. Экспериментальную экономику можно определить как направление экономической науки, посвященное использованию метода контролируемого эксперимента с целью тестирования предсказаний экономической теории и изучения поведения экономических агентов. Экономический эксперимент является искусственным воспроизведением экономических процессов и явлений с целью их изучения в контролируемых условиях.

В работе выделены следующие предпосылки возникновения экспериментальной экономики:

Развитие междисциплинарных исследований и взаимодействие экономики с психологией. Первой социальной наукой, начавшей использовать экспериментальные методы в начале XX века, стала психология. В связи с этим в экономике первые попытки экспериментирования были проведены психологами, работавшими над связанными с экономическим поведением проблемами. Именно взаимодействие экономики с психологией и, в общем, развитие междисциплинарных исследований стало одной из основных предпосылок появления экспериментальной экономики. Во времена зарождения и развития микроэкономической теории в XX веке психология еще не полностью сформировалась как наука, в связи с чем существовало недоверие к результатам психологических исследований, и ученые, занимавшиеся микроэкономикой, не имели возможности использовать эти результаты при разработке моделей поведения индивидов.

Идея использования экспериментальных методов не является новой, но долгое время их развитие сдерживалось вследствие царившей в экономической науке еще со времен маржиналистской революции излишней оптимистичности в отношении новых достижений науки, таких

как ординалистская теория полезности или теория общего экономического равновесия, которые не предполагали использования результатов исследования психологических аспектов человеческого поведения.

По мере развития экономической науки многочисленные расхождения предсказаний теории с эмпирическими данными показали необходимость доработки и изменения теории с принятием во внимание таких психологических аспектов как когнитивные ограничения, существование факторов социального статуса, стремление к справедливости и социальному одобрению в поведении экономических агентов.

Развитие теории игр стало другой важной предпосылкой, так как работающие в ней исследователи использовали эксперименты с целью обоснования своих теоретических выкладок или в качестве иллюстрации парадоксов.

Развитие моделирования. По окончании Второй мировой войны произошли изменения в самой экономике: она из «моральной науки» превратилась в науку, базирующуюся на инструментах. Активное использование математики, статистики и моделирования в экономической науке сыграло важную роль в появлении экспериментальной экономики.

Особенности методологии экспериментальной экономики и проблемы ее применения. Предметом исследования экспериментальной экономики является проведение в контролируемых условиях лаборатории экспериментов, призванных тестировать гипотезы экономической теории. Объектом изучения являются гипотезы о поведении субъектов экономических отношений и механизмы реализации закономерностей их поведения.

Можно выделить четыре *функции* экспериментальной экономики:

- оценка объяснительной силы теорий - тестирование гипотез, выработанных как в рамках сформулированной теории, так и в качестве интуитивных выкладок индуктивного метода исследования;

- производство новых знаний - поиск закономерностей в фактическом поведении экономических субъектов и изучение малоизвестных с теоретической точки зрения ситуаций;

- помощь в принятии решений - функция экспертизы, формулирование рекомендаций для государственных или частных структур;

- обучающая функция - экспериментальная экономика может улучшить процесс обучения экономическим дисциплинам, предлагая с помощью экспериментов очень наглядное и интерактивное объяснение существующих теорий, зачастую очень абстрактных.

Обычно выделяют три основных *составляющих* экономического эксперимента: среда (стартовый фонд, предпочтения и затраты, которые побуждают участников к обмену в процессе эксперимента), институты, позволяющие определить способ коммуникации, правила обмена информацией и правила, посредством которых происходит превращение информации в рыночные контракты и поведение участников.

В своих исследованиях экспериментальная экономика использует разные *категории субъектов*. Эксперимент может проводиться с участием студентов, детей, племен, специалистов, определенных группы людей или даже животных.

В экспериментальной экономике используются три *техники* проведения экспериментов: «вручную» с использованием анкет в бумажном виде; информатизированные эксперименты, проводящиеся в специально оборудованных компьютерных классах; эксперименты с использованием сканеров или МРТ, с помощью которых регистрируется мозговая активность участников эксперимента.

Проведение эксперимента подразумевает прохождение четырех *этапов*. На первом этапе проводится отбор теоретических предсказаний, которые необходимо протестировать. На втором этапе формулируются правила проведения эксперимента, и разрабатывается протокол, фиксирующий среду, институт обмена, средства вознаграждения участников и процедуру проведения эксперимента. Третий этап представляет собой непосредственно сам экономический эксперимент. Чаще всего эксперимент проводится в специально оборудованной лаборатории, в которой участники изолированы друг от друга и взаимодействуют опосредованно через информационные сети. Каждому участнику на экране выводится информация о ходе игры и предлагается ответить на вопросы или выбрать одну из моделей поведения. На заключительном этапе эксперимента его организатор анализирует полученные результаты с помощью статистических и эконометрических методов.

Большинство эксперименталистов сходятся на четырех основных *принципах* проведения экспериментов:

1. Воспроизводимость экспериментов.
2. Анонимность участников.
3. Вознаграждение участников в зависимости от их успехов.
4. Правдивость – отсутствие обмана участников.

Основной *проблемой*, поднимаемой в свете исследований по экспериментальной экономике, является проблема «внешней валидности» или «параллелизма». Она заключается в сходстве между экспериментальными моделями и реальностью, то есть возможности экстраполи-

ровать результаты, полученные в лаборатории, на реальный мир. Поведение участников эксперимента может отличаться от их реального поведения в силу многих причин, таких как замена реального поведения на исполнение определенной «роли» в ходе эксперимента, частое участие студентов как специфической группы населения, недостаточная денежная мотивация участников. Кроме того, по мнению некоторых ученых, используемые в экспериментах институты являются искусственно заданными ограничениями, отличающимися от реально существующих.

Другим дискуссионным вопросом в экспериментальной экономике является проблема мотивации субъектов исследования. В настоящее время практически повсеместно используется денежное вознаграждение участников. Но денежное вознаграждение не может решить всех проблем, таких как сложности изучения поведения людей при риске потерь или ограничения в бюджете эксперимента.

Реакцией эксперименталистов на критику является стремление усовершенствовать эксперименты, принимая во внимание подвергающиеся критике аспекты. Например, эксперименталисты начинают приглашать профессионалов для участия в экспериментах, увеличивают денежное вознаграждение или начинают осваивать так называемые «полевые эксперименты», которые проводятся в контролируемых, но реальных условиях.

Периодизация истории экспериментальной экономики. Проведенный автором анализ истории экспериментальной экономики, начиная с первых попыток экспериментирования в экономике по настоящее время, позволил осуществить ее периодизацию. В качестве критерия периодизации принята степень зрелости экспериментальной экономики и уровень ее развития, а также количество исследований, проводимых в данной области на каждом временном промежутке.

История экспериментальной экономики в работе разделена на пять этапов:

1. Первые разрозненные эксперименты: начало XVIII века – начало XX века;
2. Зарождение: середина 40-х – начало 60-х годов XX века;
3. Медленное развитие: 60-е – 70-е годы XX века;
4. Подъем: начало 80-х – середина 90-х годов XX века;
5. Всеобщее признание: с середины 90-х годов XX века по настоящее время.

В диссертационном исследовании представлена оценка основных достижений в рамках каждого этапа, выявлены основные представители экспериментальной экономики, а также определено значение каждого этапа (таблица 1).

Таблица 1 –Характеристика этапов истории экспериментальной экономики.

Этапы	Основные представители	Основные достижения и вехи	Значение этапа
Первые разрозненные эксперименты (начало XVIII века – начало XX века)	Даниил и Николай Бернулли И. Фишер У. Джевокс	-Формулировка Санкт-Петербургского парадокса. -Первые попытки экспериментально тестировать экономические теории. -Первое опубликование в научном издании результатов контролируемого эксперимента.	Первые попытки экспериментирования в экономике, зародившие среди ученых интерес к продолжению этих работ.
Зарождение экспериментальной экономики (середина 40-х – начало 60-х годов XX века)	Л. Л. Терстон С. Руссеас и А. Харт Дж. Фон Нейман и О. Моргенштерн М. Престон и Ф. Баратта Ф. Мостеллер и Ф. Ноги М. Алле К. Мзя Д. Эллсберг М. Флуд и М. Дрешер Э. Чемберлин С. Зигель и Л. Фуракель Р. Зельтен и Х. Саурерманн В. Смит	-Первые эксперименты по индивидуальному выбору в детерминированных условиях. -Формулировка теории ожидаемой полезности. -Формулировка парадоксов Алле и Эллсберга, ее опровергающих. -Формулировка «Дилеммы Узника». -Первое воспроизведение в искусственных условиях университетской аудитории функционирования рынка совершенной конкуренции Чемберлином. -Проведение инновационных экспериментов в области переговоров в условиях билатеральной монополии, дуополии и олигополии. -Создание первой в мире организованной постоянной рабочей группы по исследованиям в области экспериментальной экономики. -Первая широко известная конференция в области принятия решений, отчасти посвященная экспериментальным методам, в Санта-Монике в США осенью 1952 года.	Зарождение экспериментальной экономики стало возможным в последующие годы в результате совокупности разрозненных исследований представителей различных дисциплин и их немногочисленных совместных действий. Исследования проводились параллельно в области индивидуального принятия решения, интерактивного взаимодействия и индустриальной организации. Основные исследования были предприняты в США и сосредоточены в нескольких крупных исследовательских центрах.
Медленное развитие (конец 60-х – 70-е годы XX века)	Дж. Фридман В. Смит Ч. Плотт В. Гут Р. Зельтен М. Алле А. Тверски Д. Канеман С. Ликтенштейн	-Проведение первого симпозиума по экспериментальной экономике. -Создание первой большой информатизированной «лаборатории по экономической науке» в университете Аризона. -Опубликование Верноном Смитом работы, ставшей фундаментальной методологической основой для эксперименталистов в 1976 году. -Опубликование на английском языке полной версии статьи Мориса Алле 1953 года. -Опубликование основополагающих работ Тверски и Канемана 1974 года и Ликтенштейн и Словик 1971 года, положивших начало расхождению во взглядах ученых.	В этот период появляются важные в будущем сотрудничества (Канеман и Тверски, Смит и Плотт). К началу 80-х годов уже были опубликованы результаты основополагающих экспериментов, определивших дальнейшее развитие исследований в русле экспериментальной экономики, она все больше отделяется от психологии и готова войти в мейнстрим.

Продолжение таблицы 1.

<p>Подъем эксперимента 90-х годов XX века</p>	<p>П. Словик Р. Тиец Х. Саурманн</p>	<p>-Опубликование в 1967 году «Взгляд в экспериментальную экономику» Хейнцом Саурманном, где он впервые использует термин «экспериментальная экономика». -Конец 70-х – начало 80-х годов стало временем активного развития теории альтернативных теорий ожидаемой полезности.</p>	<p>Этому способствовало появление информатизированных лабораторий, а также научный контекст того времени, (угасание теории общего равновесия, нестабильность в микроэкономике и разочарование в эконометрике).</p>
<p>Полное признание экспериментальной экономики (начало 80-х – середина 90-х годов XX века)</p>	<p>Р. Батталлио Дж. Кагэль А. Вильямсон Дж. Уолкер С. Холгитт Р. Форсит Э. Рот Ч. Хольц</p>	<p>-Опубликование в 1991 году Палфрей и Портером статьи «Рекомендации по опубликованию работ по экспериментальной экономике». -Создание европейской сети эксперименталистов в экономике и появление лабораторий в разных странах.</p>	<p>Решающий этап в истории развития экспериментальной экономики. В этот период значительно увеличивается количество проводимых экспериментов и ученых, работающих в данной области, появляются лаборатории в разных странах, увеличивается количество публикуемых по теме статей. Большинство международных коллоквиумов начинает включать в программу специальные сессии, посвященные экспериментам в экономике. В свет выходит первые учебники по экспериментальной экономике, рассчитанные на более широкую аудиторию. Пронсходит дифференциация научного сообщества, отделение поведенческой экономики.</p>
<p>Всеобщее признание экспериментальной экономики (середина 90-х годов XX века – настоящее время)</p>	<p>Ч. Холт Э. Рот В. Смит и др.</p>	<p>-9 октября 2002 году Нобелевский комитет присудил премию в области экономики Вернону Смиту «за утверждение лабораторных экспериментов в качестве инструмента эмпирического анализа в экономике, в особенности при исследовании альтернативных рыночных механизмов». -В 1995 году выходит в свет первое «Руководство по экспериментальной экономике» («Handbook of experimental economics») -В 1998 году Чарльз Холт создает журнал, целиком посвященный экспериментальной экономике – «Experimental Economics». -В 2012 году Нобелевскую премию присудили Элвину Роту и Ллойд Шелли «за теорию стабильного распределения и практику устройства рынков».</p>	<p>Признание экспериментальной экономики в качестве направления экономической науки: опубликование большого количества статей по теме, появление специализированных журналов и организаций, присуждение двух Нобелевских премий специалистам по экспериментальной экономике.</p>

Российский опыт применения экспериментальных методов в экономике. Регулярные исследования с применением методов экспериментальной экономики в России начались с середины 80-х годов, но на настоящий момент еще не имеют той значимости и известности, которые они приобрели в западных странах. Исследования, близкие экспериментальной экономике, в России проводятся в рамках двух направлений. Первое направление, возникшее сравнительно недавно, представлено исследованиями в рамках классической в западном понимании экспериментальной экономики. Ведущим исследовательским центром является Лаборатория экспериментальной и поведенческой экономики ВШЭ.

Второе, доминирующее в российской науке направление исследований, имеет более давнюю историю и представлено исследованиями с применением математического моделирования сложных систем. Оно направлено преимущественно на системный анализ экономики России и количественную оценку деятельности государства. Основным исследовательским центром является Лаборатория экспериментальной экономики ЦЭМИ.

Существует необходимость развития экспериментальных методов в России и проверки результатов экспериментов, проведенных в других странах, в российской действительности с целью выяснения, существования различия в результатах в связи с менталитетом населения и особенностями институциональной среды, унаследованной от социалистического прошлого страны. Такие исследования могли бы помочь целенаправленному и эффективному реформированию существующих экономических механизмов и синтезу новых, а также отбраковке неэффективных вариантов развития.

Различия между экспериментальной и поведенческой экономикой. В 80-е годы XX века различия в исследовательской программе и разница в интерпретации результатов экспериментов в рамках экспериментальной экономики привели к выделению в отдельную область поведенческой экономики. Она отличается от первоначального подхода эксперименталистов в первую очередь тем, что стремится дать экономической теории новую базу, основанную на психологических аспектах поведения, проверенных как экспериментальным, так и другими путями и акцентируют внимание на лимитах рациональности индивидов. Родоначальниками данного направления считаются Амос Тверски, Даниэль Канеман и Ричард Талер. Именно Даниэлем Канеманом и Амосом Тверски была разработана теория перспектив - теория принятия решений альтернативная теории ожидаемой полезности Фон Неймана и

Моргенштерна, внесшая важный вклад в область индивидуального принятия решений.

Поведенческая экономика отличается от экспериментальной экономики в первую очередь тем, что она предлагает пересмотр теоретической базы экономической науки с включением в нее результатов анализа реального поведения людей и в большей степени противопоставляет себя неоклассической экономике, чем экспериментальная экономика, ставящая своей главной целью проверку выводов экономических теорий.

Некоторые ученые считают экспериментальную и поведенческую экономики двумя программами одного и того же направления. Проведенный анализ привел нас к другой точке зрения, согласно которой экспериментальная и поведенческая экономики являются двумя хотя и тесно взаимодействующими, но отдельными направлениями науки. Несмотря на всю свою близость, эти два направления имеют разные цели и разные исследовательские программы, поведенческая экономика изучает иррациональное поведение изолированных агентов, а экспериментальная экономика – регулирующее воздействие рынка как результат взаимодействия между агентами, обладающими ограниченной рациональностью.

В настоящее время происходит обратный процесс интеграции экспериментальной и поведенческой экономик, о чем свидетельствует вручение Нобелевской премии одновременно двум ее представителям – Вернону Смиту и Даниэлю Канеману, а также призывы к сближению двух научных программ со стороны самих ученых, в первую очередь, Вернона Смита.

Вклад экспериментальной экономики в экономическую науку. Новаторство подхода представителей экспериментальной экономики заключается в том, что они постулируют существование двух видов рациональности, совместно руководящих деятельностью человека: конструктивистской и экологической. Данный подход сформировался под влиянием идей Герберта Саймона, который различает «субстантивную» и «процедуральную» рациональность.

В основе *конструктивистской рациональности* лежит понятие рационального человека в традиционном понимании неоклассической теории, то есть максимизирующего свою выгоду при помощи сознательного размышления над ситуацией.

Результаты лабораторных экспериментов показали, что если в рамках неперсонифицированного обмена выводы стандартной теории часто подтверждаются, и более того, схождение к рыночному равновесию происходит даже при более «мягких» условиях, чем в теории, то при

персонифицированном обмене, в частности в рамках интерактивной игры между двумя участниками, наблюдается множество отклонений от предсказаний теории в сторону кооперации. Вернон Смит объясняет такие отклонения врожденной склонностью людей к повторяющемуся социальному обмену, в котором наличие кооперативного поведения обусловлено присутствием позитивной и негативной реципрокности (одной из форм социального обмена - обмена дарами на вне рыночной основе на условиях взаимности), а также чувства справедливости, которыми они руководствуются помимо стремления получения выгоды.

Другим упущением стандартной теории является ее неспособность объяснить «правильное» функционирование рынка при «мягких» условиях, таких как ограниченное количество продавцов и покупателей, не владеющих полной, общей или совершенной информацией, что не соответствует условиям функционирования рынка в теории, но было показано в ходе экспериментов по проведению непрерывного двойного аукциона. Они показали, что при владении участниками полной и общедоступной информацией, достижение равновесия по Нэшу происходит менее эффективно, чем при доступности им только частной информации. Условие владения полной и совершенной информацией, свойственное картезианскому рационализму, не может быть выполнено в реальности, поскольку выходит за границы человеческих возможностей.

Представители экспериментальной экономики не отрицают конструктивистской рациональности, но указывают на ее границы, когда в действие вступают другие механизмы, возникающие вследствие альтернативных издержек принятия решения и других издержек, связанных с внешней средой. Они получили название *экологической рациональности*.

В рамках данного вида рациональности изучается не обдуманное поведение агентов как при конструктивистской рациональности, а их поведение на основе опыта и обыденных знаний. В научной программе экспериментальной экономики соединяются конструктивистский и экологический подходы. В тех случаях, когда результаты эксперимента расходятся с предсказаниями теории в соответствии с конструктивистским подходом, предлагается попытаться изучить девиантные реакции индивидов в рамках экологической рациональности.

В рамках неперсонифицированного рыночного обмена эксперименты по исследованию динамики конкурентного рынка показали что, даже при участии ограниченного количества участников, наблюдается приближение реальных рыночных цен к прогнозируемому уровню. Кроме того, результатом исследований стали выводы о положительном влиянии накопления агентами опыта на эффективность

рынка, о способствовании роста объема продаж процессу ускорения достижения равновесия. Эксперименты показали, что увеличение спроса, не вызывающее дестабилизацию рынка, ведет к усилению тенденции схождения цен к равновесному уровню, а существование монополиста ведет к превышению цен над равновесными, но не настолько, как это предсказывает теория.

Исследования позволили сделать вывод о важности институтов, которые определяют доступную участникам экономического взаимодействия информацию и их стимулы к обмену, что, в свою очередь, влияет на эффективность взаимодействия. В свете разочарования в рациональности индивидуумов, не нужно исключать возможность появления рационального поведения при многократно повторяющимся по одним и тем же правилам взаимодействиям между агентами. Всеобщая информированность не обязательно подразумевает возникновение общих ожиданий (общего знания), поскольку каждый игрок не знает, как остальные участники распорядятся данной информацией, а появление общего знания об ожиданиях других игроков связано с накоплением опыта участниками.

Экспериментальные исследования позволили разработать поведенческую теорию игр, основанную на стандартной теории игр, но лишенной слишком жестких изначальных предпосылок о человеческой природе (стремление к собственной выгоде, неограниченные когнитивные способности). Достигнутые в данной области результаты являются следствием экспериментов по изучению таких понятий как реципрокность, «чтение мыслей» (возможность предугадывать поведение других людей посредством анализа их поступков, жестов или слов) и чувство справедливости. Анализ результатов экспериментов с играми позволили ученым сделать выводы о важности принятия во внимание стратегий поощрения и наказания, используемых людьми при групповых взаимодействиях.

В теории игр считается, что доминирующие стратегии можно не брать в расчет, так как они не являются рациональными, но результаты экспериментов показывают, что в повторяющихся играх участники действительно используют доминирующие стратегии.

Характеристика современного состояния экспериментальной экономики и перспективы ее развития. За свою недолгую историю экспериментальная экономика прошла сложный путь от занимаемого ей в прошлом второстепенного места к положению фундаментального инструмента экономического исследования. В настоящее время экспериментальная экономика признана научным сообществом как одно из направлений экономической теории. Об этом свидетельствуют такие

факты, как наличие специализированного журнала, специализированной научной ассоциации, основополагающих изданий и специализированных сайтов. За последние 40 лет значительно возросло количество научных работ, использующих экспериментальные методы. В настоящее время экономические эксперименты проводятся в 30 странах мира в 180 лабораториях. Но именно присуждение в 2002 году Нобелевской премии отцу экспериментальной экономики Вернону Смиуту ознаменовало признание данного направления научным сообществом.

Можно выделить следующие основные черты экспериментальной экономики на современном этапе ее развития, которые являются также и признаками ее зрелости в качестве отдельного научного направления:

- диверсификация экспериментальных исследований и появление новых видов экспериментов, таких как контролируемые «полевые эксперименты»;
- расширение границ экспериментальной экономики и появление новых направлений, таких как нейроэкономика;
- диверсификация объекта исследования в экспериментальной экономике – проведение все большего числа экспериментов для государственных структур и частных фирм;
- интерес к экспериментальной экономике со стороны специалистов по философии и методологии науки.

На сегодняшний день эксперименты проводятся почти во всех областях экономики, к числу которых можно отнести:

- индивидуальное принятие решений в условиях риска и неопределенности;
- теория игр;
- теория рынков (исследования конкурентного рынка, монополии, дуополии, финансовых рынков);
- теория аукционов;
- экономика информации (исследования в области нежелательного отбора);
- теория общественных благ (изучение проблемы безбилетника и внешних эффектов).

В диссертационной работе выделен ряд преимуществ, которыми обладает лабораторный эксперимент по сравнению с традиционными методами экономической науки. Это возможности: изучать явления в контролируемых и наиболее четко заданных условиях; изолировать влияние экзогенных факторов, которые могли бы фальсифицировать результаты; варьировать экзогенные факторы с целью выявления детерминистских связей между явлениями, а также выявления степени их

влияния; проверять надежность результатов и судить об их общем характере при помощи повторения эксперимента в идентичных условиях; изучать институты, не существующие в реальности или ситуации, никогда еще не имевшие место; оценивать влияние тех или иных мер государственного регулирования на поведение агентов еще до их введения.

Результаты исследований в рамках экспериментальной экономики на сегодняшний день являются настолько солидными, что их невозможно игнорировать. Многие ученые отмечают кризисное состояние экономической науки, связанное в первую очередь с ее абстрактным характером и с несоответствием предсказаний теории наблюдаемым в реальности фактам. В такой ситуации в научную программу мейнстрима начинают интегрироваться все новые и новые направления, раньше не признаваемые научным сообществом, такие как теория игр, экспериментальная и поведенческая экономики, которые могут помочь модифицировать модели таким образом, чтобы как можно больше приблизить их к действительности, что в будущем должно привести к видоизменению неоклассической науки.

Выделение экспериментальной экономики в качестве научного направления означает смещение акцентов в экономике с разработки теоретических математических моделей на эмпирическую проверку предсказаний теории и оценку их согласованности с реальным поведением индивидов и рынков.

Заслугой экспериментальной экономики является не только открытие новых ранее неизвестных фактов и феноменов, характерных для человеческого поведения, и введение в экономическую науку новых методов исследования, но также появление новой модели взаимодействия между представителями различных дисциплин и укрепление связей между теоретическими и эмпирическими данными.

Экспериментальные исследования имеют большой потенциал в практическом применении. Экспериментальная экономика уже добилась значительных результатов в изучении индивидуального и группового поведения и доказала несостоятельность некоторых экономических моделей, но исследования дают неоднозначные результаты, что указывает на необходимость дальнейшего изучения таких аспектов, как, например, ограниченная рациональность экономических агентов или понятие реципрокности.

Экспериментальные исследования в экономике показали, что даже несмотря на подчас крайне абстрактный характер теории, ее выводы достаточно часто подтверждаются на практике, особенно в рамках неперсонифицированного обмена, но в то же время исследования выявили

много факторов, неучтенных в моделях и показали незавершенность теории. Именно в этой незавершенности содержится основной мотивирующий фактор будущих экспериментальных исследований.

III. ОСНОВНЫЕ НАУЧНЫЕ ПУБЛИКАЦИИ ПО ТЕМЕ ДИССЕРТАЦИОННОГО ИССЛЕДОВАНИЯ

1. **Беляева, А.Д. Эволюция степени вмешательства государства в экономику в XX в. / А.Д. Беляева // Известия Санкт-Петербургского университета экономики и финансов. – 2011. – № 5. – 0,4 п. л.**
2. **Беляева, А.Д. История зарождения экспериментальной экономики / А.Д. Беляева // Известия Санкт-Петербургского университета экономики и финансов. – 2013. – № 2. – 0,4 п. л.**
3. **Беляева, А.Д. Предпосылки возникновения экспериментальной экономики и ее признание как научного направления / А.Д. Беляева // Известия Санкт-Петербургской лесотехнической академии. – 2013. – № 2. – 0,8 п. л.**
4. **Беляева, А.Д. Этапы и техника проведения лабораторных экспериментов в экономике // Экономика и политика России в переходный период. Научная сессия профессорско-преподавательского состава, научных сотрудников и аспирантов по итогам НИР 2011 года. Март-апрель 2012 года. Факультет экономической теории и политики: сборник докладов / А.Д. Беляева; под ред. В. А. Грошева, А. В. Лабудина. – СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 2013. – 0,5 п. л.**

БЕЛЯЕВА АННА ДМИТРИЕВНА
АВТОРЕФЕРАТ

Лицензия ЛР № 020412 от 12.02.97

Подписано в печать 28.05.13. Формат 60x84 1/16. Бум. офсетная.
Печ. л. 1,4. Бум. л. 0,7. Тираж 70 экз. Заказ 238.

Издательство Санкт-Петербургского государственного
экономического университета
191023, Санкт-Петербург, Садовая ул., д. 21.